

申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	46
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	48

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	49
9 开放式基金份额变动	49
10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	51
11 影响投资者决策的其他重要信息	51
12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)
基金简称	申万菱信量化小盘股票(LOF)
场内简称	申万量化
基金主代码	163110
交易代码	163110
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月16日
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	224,741,617.27 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年8月1日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用数量化的投资方法精选个股，严格按照纪律执行，力争获取长期稳定的超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金坚持数量化的投资策略，专注于小盘股的投资。基金管理人基于对国内股票市场的大量实证研究，专门开发了适合小盘股投资的数量化投资模型（简称“量化小盘投资模型”），作为本基金投资的核心。本基金的股票选择行为，都是基于该投资模型而定。这种完全基于模型的数量化投资方法能够更加客观、公正而理性的去分析和筛选股票，并且不受外部分析师的影响，极大的减少了投资者情绪的影响，从而能够保持投资策略的一致性与有效性。
业绩比较基准	90%×中证 500 指数收益率+10%×银行同业存款收益率（税后）
风险收益特征	本基金是一只量化股票型基金，属于较高预期风险和较高预期收益的证券投资品种，其风险收益特征从长期平均来看高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		申万菱信基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王菲萍	郭明
	联系电话	021-23261188	010-66105799
	电子邮箱	service@swsmu.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008808588	95588
传真		021-23261199	010-66105798

注册地址	上海市中山南路100号11层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	上海市中山南路100号11层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200010	100140
法定代表人	刘郎	陈四清

注：2021年7月1日起，申万菱信基金管理有限公司法定代表人变更为陈晓升，原法定代表人刘郎达法定退休年龄退休。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.swsmu.com
基金中期报告备置地点	申万菱信基金管理有限公司 中国工商银行股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
基金保证人	-	北京市西城区太平桥大街 17 号

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年1月1日至2021年6月30日）
本期已实现收益	11,780,882.31
本期利润	42,568,236.48
加权平均基金份额本期利润	0.2451
本期加权平均净值利润率	11.14%
本期基金份额净值增长率	9.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	248,993,994.89
期末可供分配基金份额利润	1.1079
期末基金资产净值	525,843,877.08
期末基金份额净值	2.3398
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	296.84%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认/申

购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认/申购或交易基金的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.37%	0.78%	1.07%	0.65%	2.30%	0.13%
过去三个月	11.34%	0.73%	7.97%	0.61%	3.37%	0.12%
过去六个月	9.13%	1.16%	6.31%	0.89%	2.82%	0.27%
过去一年	26.63%	1.29%	14.65%	1.12%	11.98%	0.17%
过去三年	57.80%	1.32%	28.25%	1.33%	29.55%	-0.01%
自基金合同生效起至今	296.84%	1.48%	50.76%	1.49%	246.08%	-0.01%

注：本基金的业绩基准指数=90%×中证 500 指数收益率+10%×银行同业存款收益率（税后）。

其中：中证 500 指数作为衡量股票投资部分的业绩基准，银行同业存款收益率作为衡量非股票投资部分的业绩基准。本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{benchmark}(0) = 1000;$$

$\% \text{benchmark}(t) = 90\% * (\text{中证 500 指数}(t) / \text{中证 500 成分指数}(t-1) - 1) + 10\% * \text{银行同业存款利率}(\text{税后}) / 365;$

$$\text{benchmark}(t) = (1 + \% \text{benchmark}(t)) * \text{benchmark}(t-1);$$

其中 $t=1,2,3,\dots$ 。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011 年 6 月 16 日至 2021 年 6 月 30 日)



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

申万菱信基金管理有限公司(SWS MU Fund Management Co.,Ltd)成立于 2004 年 1 月 15 日,公司总部设在上海,注册资本 1.5 亿元,净资产超过 10 亿元。

申万菱信基金自成立以来,始终将持有人的利益放在首位,秉持“研究至善”的愿景、“长期致胜”的使命,遵循“诚于心、行于矩、敏于变”的企业价值观。近年来,申万菱信基金围绕市场和客户需求,逐渐形成“投资美好生活、创新理财服务”的产品规划;通过努力打造“美好生活”系列权益产品,不断丰富“全市场、宽基指数与增强、主题指数、量化对冲、固收+、另类投资和纯固收”等产品大类,致力于为持有人提供“温暖陪伴”的产品服务,以努力达成“长期致胜”的使命。公司现有开放式公募基金 54 只,资产管理总规模超过 1100 亿元,产品累计分红 144 亿元(数据截至 2021 年 6 月 30 日)。

近年来,申万菱信基金通过建设关键假设平台(Key Assumption Platform),推动“研究数字化”;通过基金经理的风格开发、稳定和优化,推动“投资风格化”;通过风险管理工作的关口前移,加强市场风险管理支持,推动“风控全流程”,从而不断建设申万菱信基金的“机构理性”,以提升投资业绩。此外,申万菱信基金还持续打造卓越战略与产品管理体系(Excellent Strategy & Product)、卓越品牌与客户服务体系(Excellent Branding & Service),提升面向不同类别客户的全方位专业服务水平。

申万菱信基金股东实力雄厚,中央汇金公司控股的申万宏源证券持有公司 67%的股份,日本三

菱 UFJ 信托银行持有公司 33% 的股份。申万菱信基金拥有公开募集证券投资基金管理人、特定客户资产管理人、合格境内机构投资者(QDII)管理人、保险资金投资管理人等业务资格，并全资设立申万菱信（上海）资产管理有限公司，专门从事特定客户资产管理业务和专项资产管理业务。公司曾多次荣获中国基金业金牛奖、中国明星基金奖、中国金基金奖等多项业内重量级奖项以及东方财富“最佳指数投资团队”等荣誉。

展望未来，申万菱信基金将紧紧依托双方股东优势，不断深化体制机制改革，以更加市场化的导向推动专业队伍的全方位发展，努力将公司打造成为一家优秀乃至卓越的资产管理机构。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
俞诚	本基金 基金经 理	2020-04-15	-	11 年	俞诚先生，经济学学士、2009 年起从事金融相关工作，2009 年 08 月加入申万菱信基金管理有限公司，曾任产品与金融工程总部金融工程师、数量研究员，申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金、申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金、申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、申万菱信价值优享混合型证券投资基金、申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF) 基金经理，现任申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金、申万菱信量化驱动混合型证券投资基金、申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)、申万菱信价值优利混合型证券投资基金、申万菱信创业板量化精选股票型证券投资基金基金经理。
王剑	本基金 基金经	2021-03-22	-	6 年	王剑先生，博士研究生。2015 年起从事金融相关工作，曾任职于东

	理				证期货、浙商基金等。2020 年 12 月加入申万菱信基金,现任申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)基金经理。
--	---	--	--	--	---

注: 1.任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.本报告期内,公司聘任王剑担任本基金基金经理,具体见本基金管理人的相关公告。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其配套法规的规定,严格遵守基金合同约定,本着诚实信用、勤勉尽责等原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定,信息披露及时、准确、完整;本基金资产与本基金管理人与公司资产之间严格分开;没有发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为。在基金资产的管理运作中,无任何损害基金持有人利益的行为,并通过稳健经营、规范运作、规避风险,保护了基金持有人的合法权益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司制定了《公平交易办法》,通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务(包括研究分析、投资决策、交易执行等)环节中的实现,在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;同时,通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在研究分析方面,本公司建立了规范、完善的研究管理平台,规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程,使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面,首先,公司建立健全投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限。投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对投

资经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序；其次，公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外，不同投资经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；另外，公司还建立机制要求公募投资经理与特定客户资产投资经理互相隔离，且不能互相授权投资事宜。

在交易执行方面，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部，实行了集中交易制度和公平的交易分配制度：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；（2）对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（3）对于银行间市场的现券交易，交易部在银行间市场开展独立、公平的询价，并由风险管理部对交易价格的公允性（根据市场公认的第三方信息）、交易对手和交易方式进行事前审核，确保交易得到公平和公允的执行。

在日常监控和事后分析评估方面，本公司风险管理部开展日内和定期的工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。其中日常监控包括了日内不定点对交易系统的抽查监控；对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控；以及对银行间交易过程中投资组合与交易对手之间议价交易的交易方式和交易价格的公允性进行审查。事后分析评估上，风险管理部在每个季度和每年度的《公平交易执行报告》中，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司制定了《异常交易监控与报告办法》，明确定义了投资交易过程中出现的各种可能导致不公平交易和利益输送的异常交易类型，并规定且落实了异常交易的日常监控、识别以及事后的分析流程。

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期，未发生我司旗下投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况以及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年,经济处于不断复苏的阶段,流动性宽松的时刻可能已经过去。A 股市场依旧呈现的是结构性牛市,以半导体、新能源为代表的行业出现了较大的涨幅,而以地产,水泥为代表的传统行业走势疲软。反映在投资风格上,成长因子持续优异,而低估值因子表现一般。

根据股债性价比模型,权益类资产的配置性价比持续位于中高位水平,因此,组合在今年以来股票持续维持于较高的配置比例。同时我们发现中证 500 的净利润增速高于沪深 300 的净利润增速,回顾历史上,当出现该情形时,中证 500 指数将在较长时间内跑赢沪深 300 指数。

上半年,本基金以中证 500 为基准,采取多因子选股叠加行业轮动的方法进行操作;因子层面较为均衡配置,超配低估值因子;行业层面略超配半导体,银行,低配地产。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内净值表现为 9.13%,同期业绩基准表现为 6.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,本基金将延续以中证 500 为基准的量化增强操作方式,以行业轮动和多因子模型方式进行选股,争取控制跟踪误差在 4%以内,努力做出超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所参与本基金的估值流程,上述各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人按照有关法规确定的原则进行估值,将导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的,即就拟采用的相关估值模型、假设及参数的适当性征求本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所的意见。本基金聘请的会计师事务所对相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人设立资产估值委员会,负责根据法规要求,尽可能科学、合理地制定估值政策,审议批准估值程序,并在特定状态下就拟采用的相关估值模型、假设及参数的适当性进行确认,以保护基金份额持有人的利益。

资产估值委员会由本基金管理人分管基金运营的副总经理,督察长,分管基金投资的副总经理,基金运营部、监察稽核部、风险管理部负责人组成。其中,分管基金运营的副总经理张丽红女士,拥有 17 年的基金行业运营、财务管理相关经验;督察长王菲萍女士,拥有 17 年的基金行业合规管理经验;分管基金投资的副总经理周小波先生,拥有 15 年的证券投资基金投资研究管理相关经验;基金运营部负责人严嘉惠先生,拥有 14 年的基金会计经验;法律合规与审计部(原名“监察稽核部”)总

监何一鸣先生，拥有 8 年的基金行业合规管理经验；风险管理部负责人葛诚亮先生，拥有 10 年的基金行业风险管理经验。

基金经理不参与决定本基金估值的程序。本公司已与中央国债登记结算有限责任公司签订协议，采用其提供的估值数据对银行间债券进行估值；采用中证指数有限公司提供的估值数据对交易所债券进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)的管理人——申万菱信基金管理有限公司在申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对申万菱信基金管理有限公司编制和披露的申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	33,802,314.78	32,778,929.04
结算备付金		15,291,105.69	5,410,153.83
存出保证金		3,656,156.33	231,605.60
交易性金融资产	7.4.7.2	477,160,996.14	407,916,559.79
其中：股票投资		467,129,996.14	407,803,734.19
基金投资		-	-
债券投资		10,031,000.00	112,825.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		279,328.33	1,342,215.07
应收利息	7.4.7.5	188,376.03	5,811.69
应收股利		-	-
应收申购款		300,715.33	93,580.31
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		530,678,992.63	447,778,855.33
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,266,425.61	-
应付赎回款		2,076,897.40	6,566,374.91
应付管理人报酬		526,814.71	651,885.73
应付托管费		87,802.44	108,647.63
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	734,338.14	1,390,701.86
应交税费		2,342.41	2.87
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	140,494.84	225,031.76
负债合计		4,835,115.55	8,942,644.76
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	224,741,617.27	204,681,789.29

未分配利润	7.4.7.10	301,102,259.81	234,154,421.28
所有者权益合计		525,843,877.08	438,836,210.57
负债和所有者权益总计		530,678,992.63	447,778,855.33

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.3398 元，基金份额总额 224,741,617.27 份。

6.2 利润表

会计主体：申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		49,325,422.08	74,780,649.44
1.利息收入	7.4.7.11	182,792.67	220,310.25
其中：存款利息收入		92,694.98	220,298.40
债券利息收入		90,097.69	11.85
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		18,267,130.26	86,355,109.07
其中：股票投资收益	7.4.7.12	14,967,167.90	81,386,639.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	152,864.99	63,243.08
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	69,714.56	568,816.84
股利收益	7.4.7.15	3,077,382.81	4,336,409.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	30,787,354.17	-12,108,356.58
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	88,144.98	313,586.70
减：二、费用		6,757,185.60	8,199,235.91
1. 管理人报酬		2,849,615.72	4,376,187.75
2. 托管费		474,935.94	729,364.59
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	3,283,893.24	2,946,225.90
5. 利息支出		4,547.40	-
其中：卖出回购金融资产支出		4,547.40	-
6.税金及附加		251.09	3,194.03
7. 其他费用	7.4.7.19	143,942.21	144,263.64

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		42,568,236.48	66,581,413.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		42,568,236.48	66,581,413.53

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	204,681,789.29	234,154,421.28	438,836,210.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	42,568,236.48	42,568,236.48
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	20,059,827.98	24,379,602.05	44,439,430.03
其中：1.基金申购款	85,569,532.07	104,084,578.55	189,654,110.62
2.基金赎回款	-65,509,704.09	-79,704,976.50	-145,214,680.59
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	224,741,617.27	301,102,259.81	525,843,877.08
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	499,602,868.22	319,067,245.01	818,670,113.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	66,581,413.53	66,581,413.53
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-224,779,546.16	-152,687,074.28	-377,466,620.44
其中：1.基金申购款	51,503,756.93	34,358,640.81	85,862,397.74
2.基金赎回款	-276,283,303.09	-187,045,715.09	-463,329,018.18
四、本期向基金份额持有	-	-	-

人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	274,823,322.06	232,961,584.26	507,784,906.32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：汪涛，主管会计工作负责人：张丽红，会计机构负责人：严嘉惠

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

申万菱信量化小盘股票型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 证监基金字 [2011] 525 号《关于核准申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)募集的批复》核准,由申万菱信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 512,877,725.48 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字 (2011) 第 247 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《申万菱信量化小盘股票型证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2011 年 6 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 512,987,683.05 份基金份额,其中认购资金利息折合 109,957.57 份基金份额。本基金的基金管理人为申万菱信基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深交所深证上 [2011] 225 号文审核同意,本基金 63,363,855 份基金份额于 2011 年 8 月 1 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《申万菱信量化小盘股票型证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定,本基金投资于流动性良好的金融工具,包括国内依法发行上市的股票 (包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、资产支持证券、股指期货、股票期权以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金可以参与融资业务。本基金各类资产投资比例为:本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%,投资于本基金界定的小盘股占非现金基金资产的比例不低于 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的

5%，其中现金不包括结算备付金，存出保证金及应收申购款等。本基金投资股指期货、权证、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×90%+银行同业存款收益率（税后）×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人申万菱信基金管理有限公司于 2021 年 8 月 31 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况、2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002] 128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 46 号《关于进一步明确全面推开

营改增试点金融业有关政策的通知》、财税 [2016] 70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
活期存款	33,802,314.78
定期存款	-
其他存款	-
合计	33,802,314.78

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	434,776,848.81	467,129,996.14	32,353,147.33	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	10,032,743.62	10,031,000.00	-1,743.62
	银行间市场	-	-	-
	合计	10,032,743.62	10,031,000.00	-1,743.62
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	444,809,592.43	477,160,996.14	32,351,403.71	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	24,484,000.00	-	-	IC2108、 IC2009、 IC2112
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	24,484,000.00	-	-	IC2108、 IC2009、 IC2112

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有 1 手中证 500 指数期货 IC2108，13 手中证 500 指数期货 IC2109，5 手中证 500 指数期货 IC2112，合约市值为 25,197,800.00 元。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,471.62
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	7,487.71
应收债券利息	177,358.90
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	57.80
合计	188,376.03

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日

交易所市场应付交易费用	734,338.14
银行间市场应付交易费用	-
合计	734,338.14

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,776.12
应付证券出借违约金	-
其他应付款_其他	12,754.51
预提费用	124,964.21
合计	140,494.84

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	204,681,789.29	204,681,789.29
本期申购	85,569,532.07	85,569,532.07
本期赎回（以“-”号填列）	-65,509,704.09	-65,509,704.09
本期末	224,741,617.27	224,741,617.27

注：1、申购含转红利再投资、换入份额；赎回含转换出份额。

2、截至2021年6月30日止，本基金于深交所上市的基金份额为5,375,554.00份，托管在场外未上市交易的基金份额为219,366,063.27份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	212,618,180.77	21,536,240.51	234,154,421.28
本期利润	11,780,882.31	30,787,354.17	42,568,236.48
本期基金份额交易产生的变动数	24,594,931.81	-215,329.76	24,379,602.05
其中：基金申购款	92,752,333.54	11,332,245.01	104,084,578.55
基金赎回款	-68,157,401.73	-11,547,574.77	-79,704,976.50

本期已分配利润	-	-	-
本期末	248,993,994.89	52,108,264.92	301,102,259.81

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	57,183.41
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	12,469.20
其他	23,042.37
合计	92,694.98

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	1,078,755,918.05
减：卖出股票成本总额	1,063,788,750.15
买卖股票差价收入	14,967,167.90

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	15,494,606.01
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	15,090,847.98
减：应收利息总额	250,893.04
买卖债券差价收入	152,864.99

6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	69,714.56

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,077,382.81
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,077,382.81

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	30,073,554.17
——股票投资	30,124,123.39
——债券投资	-50,569.22
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	713,800.00
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	30,787,354.17

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	86,834.28
转换费收入	1,310.70
合计	88,144.98

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
----	----------------------------

交易所市场交易费用	3,283,893.24
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	3,283,893.24

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	35,704.06
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	378.00
账户维护费	18,000.00
上市年费	29,752.78
其他	600.00
合计	143,942.21

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
申万菱信基金管理有限公司	基金管理人 基金销售机构
申万宏源证券有限公司（以下简称“申万宏源”）	基金管理人的股东 基金代销机构
三菱 UFJ 信托银行株式会社	基金管理人的股东

中国工商银行股份有限公司	基金托管人 基金代销机构
申万菱信(上海)资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
申万宏源	841,601,620.34	38.88%	55,459,352.17	3.06%

6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
申万宏源	773,639.13	38.83%	93,114.25	12.68%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
申万宏源	50,762.04	3.05%	48,278.22	3.99%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。权证交易不计佣金。2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	2,849,615.72	4,376,187.75
其中：支付销售机构的客户维护费	1,103,886.83	1,713,506.53

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值*1.5%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	474,935.94	729,364.59

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值*0.25%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间内，本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末和上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未发生投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	33,802,314.78	57,183.41	34,500,874.35	211,343.07

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	流通受限股票	10.76	22.16	359.00	3,862.84	7,955.44	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	流通受限股票	13.39	30.08	217.00	2,905.63	6,527.36	-
688617	惠泰医疗	2020-12-30	2022-01-07	流通受限股票	74.46	372.52	1,673.00	124,571.58	623,225.96	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	流通受限股票	13.87	29.53	183.00	2,538.21	5,403.99	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	流通受限股票	13.11	24.47	322.00	4,221.42	7,879.34	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	流通受限股票	4.31	13.10	672.00	2,896.32	8,803.20	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	流通受限股票	3.37	10.44	1,112.00	3,747.44	11,609.28	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	流通受限股票	24.69	31.70	492.00	12,147.48	15,596.40	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	流通受限股票	12.76	43.35	307.00	3,917.32	13,308.45	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	流通受限股票	21.31	49.91	399.00	8,502.69	19,914.09	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	流通受限股票	5.31	28.49	443.00	2,352.33	12,621.07	-
688070	纵横股份	2021-02-02	2021-08-10	流通受限股票	23.16	34.45	2,407.00	55,746.12	82,921.15	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	流通受限股票	9.79	23.00	255.00	2,496.45	5,865.00	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	流通受限股票	4.56	18.87	474.00	2,161.44	8,944.38	-
688619	罗普特	2021-02-08	2021-08-23	流通受限股票	19.31	26.73	5,856.00	113,079.36	156,530.88	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	流通受限股票	8.67	27.39	324.00	2,808.00	8,874.36	-
688677	海泰新光	2021-02-18	2021-08-26	流通受限股票	35.76	103.10	1,768.00	63,223.68	182,280.80	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	流通受限股票	8.41	39.12	219.00	1,841.79	8,567.28	-

300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	流通受限股票	11.72	27.07	340.00	3,984.80	9,203.80	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-20	流通受限股票	28.77	99.89	240.00	6,904.80	23,973.60	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	流通受限股票	16.53	46.05	232.00	3,834.96	10,683.60	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	流通受限股票	47.33	252.43	229.00	10,838.57	57,806.47	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	流通受限股票	12.85	25.80	371.00	4,767.35	9,571.80	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	流通受限股票	12.08	23.06	234.00	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	流通受限股票	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	流通受限股票	12.13	27.73	283.00	3,432.79	7,847.59	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	流通受限股票	8.24	39.25	286.00	2,356.64	11,225.50	-
688611	杭州柯林	2021-04-01	2021-10-12	流通受限股票	33.44	45.39	1,400.00	46,816.00	63,546.00	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	流通受限股票	6.87	14.98	1,162.00	7,982.94	17,406.76	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	流通受限股票	18.24	33.37	245.00	4,468.80	8,175.65	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	流通受限股票	7.81	28.93	312.00	2,436.72	9,026.16	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	流通受限股票	28.28	145.09	318.00	8,993.04	46,138.62	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	流通受限股票	7.19	16.20	430.00	3,091.70	6,966.00	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	流通受限股票	4.54	15.34	507.00	2,301.78	7,777.38	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	流通受限股票	5.48	17.07	492.00	2,696.16	8,398.44	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	流通受限股票	33.22	105.33	449.00	14,915.78	47,293.17	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	流通受限股票	8.42	16.77	593.00	4,993.06	9,944.61	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	流通受限股票	48.59	106.28	279.00	13,556.61	29,652.12	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	流通受限股票	15.83	50.96	317.00	5,018.11	16,154.32	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	流通受限股票	24.90	27.29	295.00	7,345.50	8,050.55	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	流通受限股票	14.79	37.23	264.00	3,904.56	9,828.72	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	流通受限股票	6.79	34.76	301.00	2,043.79	10,462.76	-
688355	明志科技	2021-04-30	2021-11-12	流通受限股票	17.65	25.38	2,710.00	47,831.50	68,779.80	-
688575	亚辉龙	2021-05-10	2021-11-17	流通受限股票	14.80	41.66	3,435.00	50,838.00	143,102.10	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	流通受限股票	13.06	34.14	254.00	3,317.24	8,671.56	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	流通受限股票	12.10	23.23	410.00	4,961.00	9,524.30	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	流通受限股票	9.19	49.61	329.00	3,023.51	16,321.69	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	流通受限股票	9.36	26.89	200.00	1,872.00	5,378.00	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	流通受限股票	6.02	28.50	201.00	1,210.02	5,728.50	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	流通受限股票	4.94	17.26	928.00	4,584.32	16,017.28	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	流通受限股票	20.81	50.60	241.00	5,015.21	12,194.60	-
688117	圣诺生物	2021-05-26	2021-12-03	流通受限股票	17.90	45.87	1,672.00	29,928.80	76,694.64	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	流通受限股票	18.71	76.32	201.00	3,760.71	15,340.32	-
688700	东威科技	2021-06-07	2021-12-15	流通受限股票	9.41	48.57	3,049.00	28,691.09	148,089.93	-
688681	科汇股份	2021-06-04	2021-12-16	流通受限股票	9.56	17.15	1,899.00	18,154.44	32,567.85	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	流通受限股票	5.29	19.12	303.00	1,602.87	5,793.36	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	流通受限股票	12.54	31.22	801.00	10,044.54	25,007.22	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	流通受限股票	14.20	44.02	175.00	2,485.00	7,703.50	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	流通受限股票	7.83	22.61	218.00	1,706.94	4,928.98	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	流通受限股票	8.05	32.12	170.00	1,368.50	5,460.40	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	流通受限股票	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-
301013	利和兴	2021-06-21	2021-12-29	流通受限股票	8.72	35.33	471.00	4,107.12	16,640.43	-

301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	流通受限股票	7.64	54.81	462.00	3,529.68	25,322.22	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	流通受限股票	13.75	41.07	275.00	3,781.25	11,294.25	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股待上市	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股待上市	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股待上市	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股待上市	38.85	38.85	2,149.00	83,488.65	83,488.65	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股待上市	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股待上市	8.29	8.29	7,029.00	58,270.41	58,270.41	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股待上市	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	流通受限股票	8.29	8.29	782.00	6,482.78	6,482.78	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600811	东方集团	2021-06-30	重大事项停牌	3.05	2021-07-14	3.36	1,038,400.00	3,420,008.00	3,167,120.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为量化股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资和权证投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是量化股票型证券投资基金，属于中高风险品种，本基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使得本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“长期平均风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金”。

本基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金管理人在公司层面建立的风险管理委员会以及在董事会层面建立的风险控制委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金管理人的风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

本基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频

度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险和其他价格风险。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务而产生。

本基金的银行存款存放在本基金的托管行或其他国内大中型商业银行，本基金管理人认为与以上银行相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成债券等投资品种的交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小，本基金管理人认为在交易所进行的交易涉及的信用风险不重大。

对于银行间债券等品种的交易，本基金管理人主要通过事前检查和控制交易对手信用及交割方式来管理风险。

对于发行者的信用风险控制，本基金管理人主要通过对其投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象来管理。于本期末，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0%（上期末：0.03%）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险主要来源于基金兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

本基金管理人已经建立涵盖制度、流程、组织架构、制衡机制、风险处置等方面的流动性风险管控体系；建立以压力测试为核心、覆盖全类型产品的基金流动性风险监测与预警制度及风险应对预案。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人已经建立针对公募基金申购赎回状况的监控和预测机制以及建立了巨额赎回审批规程，对于巨额赎回建立严格的流动性评估机制；此外，本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对资产的流动性风险，本基金管理人持续监控和预测旗下基金的各项流动性指标，包括组合持仓集中度指标、投资组合在短期内变现能力的综合指标、组合持仓中变现能力较差的品种的比例控制和流通受限资产的总量控制，通过指标来持续地评估、选择、跟踪和控制投资组合的投资流动性风险。

除了上述日常流动性管理机制外，本基金管理人已建立压力测试制度，针对不同类型投资组合建立流动性压力测试模型，对各相关风险因子进行极端假设，进而评估对投资组合流动性的负面影响。此外，本基金管理人已建立流动性风险应急机制，一旦发生或认为可能发生较大的流动性风险，本基金管理人会立即启动相应的应急流程。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余是流动性较好的可在银行间同业市场交易的金融资产工具、银行存款和结算备付金，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于本期末，除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购证券款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果、流动性风险管理措施的实施以及本基金的资产和负债情况，本基金管理人认为本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。

于本期末，本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	33,802,314.78	-	-	-	-	-	33,802,314.78
结算备付金	15,291,105.69	-	-	-	-	-	15,291,105.69
存出保证金	128,464.33	-	-	-	-	3,527,692.00	3,656,156.33
交易性金融资产	-	-	10,031,000.00	-	-	467,129,996.14	477,160,996.14
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	279,328.33	279,328.33
应收利息	-	-	-	-	-	188,376.03	188,376.03
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	300,715.33	300,715.33
其他资产	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	49,221,884.80	-	10,031,000.00	-	-	471,426,107.83	530,678,992.63
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,266,425.61	1,266,425.61
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,076,897.40	2,076,897.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	526,814.71	526,814.71
应付托管费	-	-	-	-	-	87,802.44	87,802.44
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	734,338.14	734,338.14
应交税费	-	-	-	-	-	2,342.41	2,342.41
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	140,494.84	140,494.84
负债总计	-	-	-	-	-	4,835,115.55	4,835,115.55
利率敏感度缺口	49,221,884.80	-	10,031,000.00	-	-	466,590,992.28	525,843,877.08
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	32,778,929.04	-	-	-	-	-	32,778,929.04
结算备付金	5,410,153.83	-	-	-	-	-	5,410,153.83
存出保证金	231,605.60	-	-	-	-	-	231,605.60
交易性金融资产	-	-	-	-	112,825.60	407,803,734.19	407,916,559.79
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,342,215.07	1,342,215.07
应收利息	-	-	-	-	-	5,811.69	5,811.69
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	93,580.31	93,580.31
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	38,420,688.47	-	-	-	112,825.60	409,245,341.26	447,778,855.33
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,566,374.91	6,566,374.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	651,885.73	651,885.73
应付托管费	-	-	-	-	-	108,647.63	108,647.63
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-

应付交易费用	-	-	-	-	-	1,390,701.86	1,390,701.86
应交税费	-	-	-	-	-	2.87	2.87
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	225,031.76	225,031.76
负债总计	-	-	-	-	-	8,942,644.76	8,942,644.76
利率敏感度缺口	38,420,688.47	-	-	-	112,825.60	400,302,696.50	438,836,210.57

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 1.91%（上期末：0.03%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

基金的其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金的市场价格风险主要来源于本基金投资的股权和债权工具的未来价格可能受到一般市场波动或是其他影响个别股权工具价值的特定风险影响。由于本基金是一只中高风险的量化股票型基金，所以存在很高的市场价格风险。

本基金管理人通过采用数量化技术对投资策略进行优化，将特定的投资思想和理念通过具体指标与参数的设定体现在数量模型中，坚持以数量化的方式进行投资。

此外，本基金管理人在构建基金资产配置和资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差以及运用多种定量的方法对基金进行风险度量，来测试基金的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制，争取将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2021 年 6 月 30 日		2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	467,129,996.14	88.83	407,803,734.19	92.93
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	467,129,996.14	88.83	407,803,734.19	92.93

注：其他包含股指期货投资，于本期末，持仓数量为 19 手，合约市值为 25197800 元(附注 6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股股指期货投资产生的持仓损益，则其他中包含的估值期货投资与相关的期货暂收款(结算所得持仓损益)之间按抵消后的金额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.以中证 500 指数为基准衡量其他价格风险		
	2.其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	基准上升 5%	增加约 2,662	增加约 2,043
	基准下降 5%	减少约 2,662	减少约 2,043

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

一、本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2021 年 06 月 30 日，属于第一层次的公允价值计量为 464,572,834.03 元；属于第二层次的公

允价值为 12,588,162.11 元。

(a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 06 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

二、其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	467,129,996.14	88.02
	其中：股票	467,129,996.14	88.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,031,000.00	1.89
	其中：债券	10,031,000.00	1.89
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	49,093,420.47	9.25
8	其他各项资产	4,424,576.02	0.83
9	合计	530,678,992.63	100.00

注：本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,968,854.38	0.56
B	采矿业	21,844,063.00	4.15
C	制造业	302,541,573.22	57.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,529,473.39	1.81
E	建筑业	8,147,981.76	1.55
F	批发和零售业	7,559,573.04	1.44
G	交通运输、仓储和邮政业	8,031,547.00	1.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,738,578.79	6.42
J	金融业	21,716,516.14	4.13
K	房地产业	12,171,560.40	2.31
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,726,772.00	0.71
N	水利、环境和公共设施管理业	10,854,980.02	2.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	11,492,599.00	2.19
R	文化、体育和娱乐业	9,429,628.00	1.79
S	综合	3,376,296.00	0.64
	合计	467,129,996.14	88.83

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300327	中颖电子	122,806.00	10,466,755.38	1.99
2	300059	东方财富	246,856.00	8,094,408.24	1.54
3	002709	天赐材料	75,310.00	8,026,539.80	1.53
4	600089	特变电工	573,700.00	7,372,045.00	1.40

5	688099	晶晨股份	64,253.00	7,209,186.60	1.37
6	603882	金域医学	44,700.00	7,141,719.00	1.36
7	600426	华鲁恒升	226,790.00	7,019,150.50	1.33
8	300595	欧普康视	66,560.00	6,892,288.00	1.31
9	002028	思源电气	218,300.00	6,721,457.00	1.28
10	002281	光迅科技	271,900.00	6,688,740.00	1.27
11	002266	浙富控股	1,317,100.00	6,572,329.00	1.25
12	002690	美亚光电	117,600.00	6,557,376.00	1.25
13	002382	蓝帆医疗	311,500.00	6,494,775.00	1.24
14	002236	大华股份	301,800.00	6,367,980.00	1.21
15	002920	德赛西威	56,800.00	6,252,544.00	1.19
16	601233	桐昆股份	248,800.00	5,993,592.00	1.14
17	300463	迈克生物	141,300.00	5,947,317.00	1.13
18	300146	汤臣倍健	174,500.00	5,741,050.00	1.09
19	000581	威孚高科	270,900.00	5,642,847.00	1.07
20	002415	海康威视	83,400.00	5,379,300.00	1.02
21	002507	涪陵榨菜	139,593.00	5,257,072.38	1.00
22	603444	吉比特	9,504.00	5,037,120.00	0.96
23	002048	宁波华翔	253,092.00	4,935,294.00	0.94
24	002064	华峰化学	345,500.00	4,906,100.00	0.93
25	601928	凤凰传媒	671,000.00	4,790,940.00	0.91
26	000039	中集集团	255,400.00	4,643,172.00	0.88
27	600519	贵州茅台	2,200.00	4,524,740.00	0.86
28	000830	鲁西化工	239,800.00	4,491,454.00	0.85
29	603486	科沃斯	19,600.00	4,470,368.00	0.85
30	002128	露天煤业	425,700.00	4,431,537.00	0.84
31	601919	中远海控	144,800.00	4,422,192.00	0.84
32	000501	鄂武商A	375,500.00	4,393,350.00	0.84
33	300244	迪安诊断	113,600.00	4,350,880.00	0.83
34	600563	法拉电子	27,300.00	4,323,228.00	0.82
35	002013	中航机电	416,600.00	4,195,162.00	0.80
36	603568	伟明环保	183,700.00	4,193,871.00	0.80
37	600008	首创环保	1,391,700.00	4,189,017.00	0.80
38	600808	马钢股份	967,300.00	4,149,717.00	0.79
39	002311	海大集团	50,400.00	4,112,640.00	0.78
40	603260	合盛硅业	53,200.00	4,091,612.00	0.78
41	600885	宏发股份	65,000.00	4,075,500.00	0.78
42	002138	顺络电子	104,400.00	4,047,588.00	0.77
43	601899	紫金矿业	400,000.00	3,876,000.00	0.74
44	300002	神州泰岳	778,600.00	3,776,210.00	0.72
45	002030	达安基因	175,595.00	3,729,637.80	0.71
46	300012	华测检测	116,900.00	3,726,772.00	0.71
47	000825	太钢不锈	497,303.00	3,724,799.47	0.71
48	603986	兆易创新	19,740.00	3,709,146.00	0.71

49	600549	厦门钨业	177,900.00	3,705,657.00	0.70
50	002233	塔牌集团	351,900.00	3,617,532.00	0.69
51	300496	中科创达	22,300.00	3,502,438.00	0.67
52	600643	爱建集团	494,300.00	3,450,214.00	0.66
53	603589	口子窖	50,300.00	3,404,807.00	0.65
54	300166	东方国信	275,300.00	3,402,708.00	0.65
55	000009	中国宝安	184,800.00	3,376,296.00	0.64
56	601865	福莱特	84,600.00	3,344,238.00	0.64
57	603638	艾迪精密	78,000.00	3,343,860.00	0.64
58	300459	金科文化	1,029,600.00	3,325,608.00	0.63
59	601168	西部矿业	269,100.00	3,210,363.00	0.61
60	600039	四川路桥	507,100.00	3,179,517.00	0.60
61	600811	东方集团	1,038,400.00	3,167,120.00	0.60
62	300271	华宇软件	159,800.00	3,076,150.00	0.58
63	000002	万科A	126,700.00	3,016,727.00	0.57
64	002056	横店东磁	230,699.00	2,999,087.00	0.57
65	002458	益生股份	296,300.00	2,954,111.00	0.56
66	000959	首钢股份	523,600.00	2,942,632.00	0.56
67	600036	招商银行	53,900.00	2,920,841.00	0.56
68	600409	三友化工	286,200.00	2,893,482.00	0.55
69	600867	通化东宝	242,300.00	2,893,062.00	0.55
70	300618	寒锐钴业	35,200.00	2,775,168.00	0.53
71	000012	南玻A	258,000.00	2,641,920.00	0.50
72	600064	南京高科	283,300.00	2,631,857.00	0.50
73	600339	中油工程	922,200.00	2,619,048.00	0.50
74	601966	玲珑轮胎	58,800.00	2,571,912.00	0.49
75	600201	生物股份	146,000.00	2,547,700.00	0.48
76	601801	皖新传媒	539,400.00	2,545,968.00	0.48
77	600648	外高桥	171,700.00	2,537,726.00	0.48
78	002078	太阳纸业	189,800.00	2,533,830.00	0.48
79	000031	大悦城	699,259.00	2,517,332.40	0.48
80	002372	伟星新材	120,500.00	2,490,735.00	0.47
81	601139	深圳燃气	376,400.00	2,469,184.00	0.47
82	603650	彤程新材	51,000.00	2,453,100.00	0.47
83	002648	卫星石化	62,100.00	2,433,699.00	0.46
84	002142	宁波银行	61,940.00	2,413,801.80	0.46
85	603806	福斯特	21,040.00	2,211,935.20	0.42
86	002249	大洋电机	416,400.00	2,186,100.00	0.42
87	688088	虹软科技	38,570.00	2,150,277.50	0.41
88	300474	景嘉微	21,600.00	2,115,072.00	0.40
89	300133	华策影视	353,500.00	2,092,720.00	0.40
90	300113	顺网科技	158,234.00	2,047,547.96	0.39
91	002701	奥瑞金	397,100.00	2,041,094.00	0.39
92	601005	重庆钢铁	762,200.00	2,035,074.00	0.39

93	002867	周大生	102,350.00	2,023,459.50	0.38
94	002603	以岭药业	69,300.00	2,020,788.00	0.38
95	002396	星网锐捷	94,500.00	2,017,575.00	0.38
96	300274	阳光电源	17,400.00	2,002,044.00	0.38
97	000898	鞍钢股份	443,100.00	1,971,795.00	0.37
98	600048	保利地产	163,000.00	1,962,520.00	0.37
99	601689	拓普集团	51,200.00	1,916,416.00	0.36
100	601598	中国外运	376,900.00	1,903,345.00	0.36
101	600985	淮北矿业	154,900.00	1,891,329.00	0.36
102	002223	鱼跃医疗	48,800.00	1,860,744.00	0.35
103	600392	盛和资源	107,000.00	1,857,520.00	0.35
104	002092	中泰化学	180,800.00	1,856,816.00	0.35
105	600006	东风汽车	251,900.00	1,838,870.00	0.35
106	600497	驰宏锌锗	424,800.00	1,830,888.00	0.35
107	000636	风华高科	59,900.00	1,810,178.00	0.34
108	600642	申能股份	289,400.00	1,776,916.00	0.34
109	600882	妙可蓝多	25,300.00	1,765,940.00	0.34
110	002051	中工国际	274,300.00	1,747,291.00	0.33
111	600350	山东高速	277,400.00	1,706,010.00	0.32
112	600879	航天电子	223,700.00	1,682,224.00	0.32
113	601869	长飞光纤	67,100.00	1,634,556.00	0.31
114	000807	云铝股份	133,720.00	1,591,268.00	0.30
115	600256	广汇能源	472,700.00	1,574,091.00	0.30
116	600862	中航高科	50,200.00	1,545,156.00	0.29
117	600260	凯乐科技	171,000.00	1,518,480.00	0.29
118	002375	亚厦股份	191,300.00	1,515,096.00	0.29
119	600649	城投控股	316,600.00	1,507,016.00	0.29
120	002572	索菲亚	61,200.00	1,481,040.00	0.28
121	002155	湖南黄金	182,000.00	1,410,500.00	0.27
122	000738	航发控制	66,200.00	1,378,946.00	0.26
123	002156	通富微电	56,800.00	1,365,472.00	0.26
124	600970	中材国际	148,700.00	1,363,579.00	0.26
125	603515	欧普照明	53,000.00	1,360,510.00	0.26
126	002423	中粮资本	144,800.00	1,310,440.00	0.25
127	300207	欣旺达	39,600.00	1,289,376.00	0.25
128	600155	华创阳安	120,500.00	1,289,350.00	0.25
129	000990	诚志股份	101,191.00	1,288,161.43	0.24
130	002653	海思科	58,500.00	1,258,920.00	0.24
131	601128	常熟银行	199,200.00	1,235,040.00	0.23
132	600166	福田汽车	321,800.00	1,110,210.00	0.21
133	300009	安科生物	73,400.00	1,093,660.00	0.21
134	002563	森马服饰	87,900.00	1,050,405.00	0.20
135	603225	新凤鸣	51,500.00	1,045,450.00	0.20
136	002110	三钢闽光	151,500.00	1,021,110.00	0.19

137	601699	潞安环能	84,700.00	1,000,307.00	0.19
138	000488	晨鸣纸业	120,300.00	979,242.00	0.19
139	002340	格林美	102,100.00	954,635.00	0.18
140	600219	南山铝业	251,100.00	903,960.00	0.17
141	002124	天邦股份	100,100.00	701,701.00	0.13
142	603833	欧派家居	4,900.00	695,604.00	0.13
143	000887	中鼎股份	53,980.00	652,078.40	0.12
144	600782	新钢股份	115,400.00	643,932.00	0.12
145	688617	惠泰医疗	1,673.00	623,225.96	0.12
146	000685	中山公用	75,500.00	616,080.00	0.12
147	603369	今世缘	11,300.00	612,008.00	0.12
148	002926	华西证券	58,500.00	563,355.00	0.11
149	601717	郑煤机	46,400.00	539,632.00	0.10
150	600823	世茂股份	132,700.00	536,108.00	0.10
151	600859	王府井	17,900.00	516,952.00	0.10
152	600764	中国海防	17,000.00	481,100.00	0.09
153	601016	节能风电	124,400.00	465,256.00	0.09
154	002946	新乳业	29,700.00	449,955.00	0.09
155	000528	柳工	52,700.00	432,140.00	0.08
156	002670	国盛金控	35,500.00	404,345.00	0.08
157	300357	我武生物	5,100.00	327,012.00	0.06
158	601068	中铝国际	91,400.00	315,330.00	0.06
159	600418	江淮汽车	25,300.00	314,479.00	0.06
160	002901	大博医疗	3,900.00	284,271.00	0.05
161	000932	华菱钢铁	39,983.00	263,887.80	0.05
162	300953	震裕科技	2,394.00	258,651.90	0.05
163	601615	明阳智能	12,000.00	194,280.00	0.04
164	688677	海泰新光	1,768.00	182,280.80	0.03
165	300896	爱美客	223.00	175,920.24	0.03
166	688619	罗普特	5,856.00	156,530.88	0.03
167	688700	东威科技	3,049.00	148,089.93	0.03
168	688575	亚辉龙	3,435.00	143,102.10	0.03
169	600623	华谊集团	11,400.00	100,434.00	0.02
170	688499	利元亨	2,149.00	83,488.65	0.02
171	688070	纵横股份	2,407.00	82,921.15	0.02
172	600869	远东股份	16,200.00	78,246.00	0.01
173	688117	圣诺生物	1,672.00	76,694.64	0.01
174	300919	中伟股份	430.00	70,090.00	0.01
175	002419	天虹股份	10,500.00	68,880.00	0.01
176	688355	明志科技	2,710.00	68,779.80	0.01
177	000400	许继电气	5,400.00	68,364.00	0.01
178	301018	申菱环境	7,811.00	64,753.19	0.01
179	688611	杭州柯林	1,400.00	63,546.00	0.01
180	603529	爱玛科技	1,019.00	59,224.28	0.01

181	300957	贝泰妮	229.00	57,806.47	0.01
182	300929	华骐环保	1,827.00	54,888.39	0.01
183	688087	英科再生	2,469.00	54,219.24	0.01
184	300979	华利集团	449.00	47,293.17	0.01
185	002408	齐翔腾达	3,807.00	47,282.94	0.01
186	300973	立高食品	318.00	46,138.62	0.01
187	601528	瑞丰银行	2,230.00	34,721.10	0.01
188	688681	科汇股份	1,899.00	32,567.85	0.01
189	300981	中红医疗	279.00	29,652.12	0.01
190	600500	中化国际	3,500.00	27,510.00	0.01
191	301021	英诺激光	2,899.00	27,424.54	0.01
192	301015	百洋医药	462.00	25,322.22	0.00
193	301009	可靠股份	801.00	25,007.22	0.00
194	001207	联科科技	682.00	22,581.02	0.00
195	300941	创识科技	399.00	19,914.09	0.00
196	688668	鼎通科技	566.00	18,536.50	0.00
197	300968	格林精密	1,162.00	17,406.76	0.00
198	688226	威腾电气	2,693.00	17,289.06	0.00
199	301013	利和兴	471.00	16,640.43	0.00
200	300614	百川畅银	329.00	16,321.69	0.00
201	300982	苏文电能	317.00	16,154.32	0.00
202	300997	欢乐家	928.00	16,017.28	0.00
203	300932	三友联众	492.00	15,596.40	0.00
204	301002	崧盛股份	201.00	15,340.32	0.00
205	001208	华菱线缆	1,754.00	13,558.42	0.00
206	300940	南极光	307.00	13,308.45	0.00
207	300942	易瑞生物	443.00	12,621.07	0.00
208	603171	税友股份	637.00	12,230.40	0.00
209	300996	普联软件	241.00	12,194.60	0.00
210	300933	中辰股份	1,112.00	11,609.28	0.00
211	301016	雷尔伟	275.00	11,294.25	0.00
212	300966	共同药业	286.00	11,225.50	0.00
213	605287	德才股份	349.00	11,014.44	0.00
214	300955	嘉亨家化	232.00	10,683.60	0.00
215	605259	绿田机械	295.00	10,516.75	0.00
216	300987	川网传媒	301.00	10,462.76	0.00
217	300978	东箭科技	593.00	9,944.61	0.00
218	300986	志特新材	264.00	9,828.72	0.00
219	300956	英力股份	371.00	9,571.80	0.00
220	300993	玉马遮阳	410.00	9,524.30	0.00
221	300952	恒辉安防	340.00	9,203.80	0.00
222	301004	嘉益股份	312.00	9,026.16	0.00
223	300945	曼卡龙	474.00	8,944.38	0.00
224	300948	冠中生态	324.00	8,874.36	0.00

225	300931	通用电梯	672.00	8,803.20	0.00
226	300961	深水海纳	394.00	8,695.58	0.00
227	300991	创益通	254.00	8,671.56	0.00
228	300950	德固特	219.00	8,567.28	0.00
229	300975	商络电子	492.00	8,398.44	0.00
230	605162	新中港	1,377.00	8,358.39	0.00
231	300971	博亚精工	245.00	8,175.65	0.00
232	300985	致远新能	295.00	8,050.55	0.00
233	300926	博俊科技	359.00	7,955.44	0.00
234	300930	屹通新材	322.00	7,879.34	0.00
235	300963	中洲特材	283.00	7,847.59	0.00
236	300967	晓鸣股份	507.00	7,777.38	0.00
237	301011	华立科技	175.00	7,703.50	0.00
238	300972	万辰生物	430.00	6,966.00	0.00
239	300927	江天化学	217.00	6,527.36	0.00
240	300943	春晖智控	255.00	5,865.00	0.00
241	301007	德迈仕	303.00	5,793.36	0.00
242	300998	宁波方正	201.00	5,728.50	0.00
243	301012	扬电科技	170.00	5,460.40	0.00
244	300960	通业科技	234.00	5,396.04	0.00
245	300992	泰福泵业	200.00	5,378.00	0.00
246	301010	晶雪节能	218.00	4,928.98	0.00
247	605011	杭州热电	525.00	4,662.00	0.00
248	603317	天味食品	60.00	1,765.80	0.00
249	601799	星宇股份	1.00	225.72	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002920	德赛西威	14,468,879.00	3.30
2	300699	光威复材	11,534,517.87	2.63
3	601233	桐昆股份	11,018,904.00	2.51
4	002236	大华股份	10,842,839.00	2.47
5	002415	海康威视	10,817,620.00	2.47
6	002138	顺络电子	10,528,349.00	2.40
7	300496	中科创达	10,507,700.00	2.39
8	603444	吉比特	10,277,174.21	2.34
9	600426	华鲁恒升	10,169,815.24	2.32
10	002382	蓝帆医疗	9,671,549.09	2.20
11	300327	中颖电子	9,285,844.80	2.12

12	601658	邮储银行	9,120,275.00	2.08
13	601128	常熟银行	8,438,943.00	1.92
14	603486	科沃斯	8,390,984.00	1.91
15	600699	均胜电子	8,267,755.00	1.88
16	600885	宏发股份	8,253,016.00	1.88
17	000830	鲁西化工	7,928,727.00	1.81
18	603236	移远通信	7,766,057.20	1.77
19	600089	特变电工	7,615,389.00	1.74
20	002266	浙富控股	7,444,991.00	1.70

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002705	新宝股份	13,543,966.00	3.09
2	601658	邮储银行	12,452,790.00	2.84
3	601865	福莱特	12,371,160.13	2.82
4	600143	金发科技	11,547,397.00	2.63
5	300699	光威复材	11,409,465.40	2.60
6	603444	吉比特	11,278,405.00	2.57
7	300443	金雷股份	11,048,602.00	2.52
8	600507	方大特钢	10,335,564.87	2.36
9	002372	伟星新材	10,283,211.00	2.34
10	002138	顺络电子	9,618,158.00	2.19
11	000932	华菱钢铁	9,352,754.80	2.13
12	002242	九阳股份	9,289,853.62	2.12
13	601012	隆基股份	9,086,986.13	2.07
14	002839	张家港行	9,069,699.51	2.07
15	000951	中国重汽	8,618,502.12	1.96
16	002920	德赛西威	8,549,585.46	1.95
17	600988	赤峰黄金	8,517,532.20	1.94
18	600705	中航产融	8,485,440.00	1.93
19	002241	歌尔股份	8,102,000.00	1.85
20	002677	浙江美大	7,970,122.56	1.82

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,092,990,888.71
卖出股票的收入（成交）总额	1,078,755,918.05

注：“买入金额”、“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	10,031,000.00	1.91
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,031,000.00	1.91

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019645	20 国债 15	100,000.00	10,031,000.00	1.91

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2109	IC2109	13.00	17,334,200.00	560,200.00	-
IC2112	IC2112	5.00	6,521,200.00	151,200.00	-
IC2108	IC2108	1.00	1,342,400.00	2,400.00	-
公允价值变动总额合计					713,800.00
股指期货投资本期收益					69,714.56
股指期货投资本期公允价值变动					713,800.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查的情形，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,656,156.33
2	应收证券清算款	279,328.33
3	应收股利	-
4	应收利息	188,376.03
5	应收申购款	300,715.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,424,576.02

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票投资中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
25,725	8,736.31	70,040,904.43	31.17%	154,700,712.84	68.83%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	陈翠芳	669,590.00	12.46%
2	吴家驹	586,576.00	10.91%
3	吴祥宝	256,106.00	4.76%

4	孙玉侠	254,039.00	4.73%
5	宋晖	206,582.00	3.84%
6	陈勇	128,300.00	2.39%
7	章蒙恩	117,800.00	2.19%
8	谢苏民	106,583.00	1.98%
9	吴建城	100,903.00	1.88%
10	陈杭英	99,200.00	1.85%

注：以上数据由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	11,524.27	0.01%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	204,681,789.29
本报告期基金总申购份额	85,569,532.07
减：本报告期基金总赎回份额	65,509,704.09
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	224,741,617.27

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内，基金管理人董事、监事和高级管理人员未发生变更。

2、本报告期内，基金托管人资产托管部总经理由李勇先生变更为刘彤女士，刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基

金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘用毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）负责基金审计事务，未发生改聘会计师事务所事宜。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源证券	2	841,601,620.34	38.88%	773,639.13	38.83%	-
东方财富证券	2	336,489,883.28	15.55%	311,209.54	15.62%	-
方正证券	2	171,723,952.98	7.93%	158,354.18	7.95%	-
西部证券	2	140,447,322.13	6.49%	127,990.41	6.42%	-
中信建投证券	2	130,528,433.18	6.03%	118,951.09	5.97%	-
天风证券	2	118,114,757.35	5.46%	110,000.00	5.52%	-
申港证券	1	104,461,507.26	4.83%	97,284.70	4.88%	-
安信证券	1	84,692,853.52	3.91%	77,180.92	3.87%	-
东吴证券	1	52,316,824.16	2.42%	47,676.99	2.39%	-
太平洋证券	1	46,484,906.55	2.15%	43,291.58	2.17%	-
海通证券	2	38,073,618.83	1.76%	35,458.02	1.78%	-
中泰证券	3	31,340,298.26	1.45%	29,187.14	1.46%	-
东北证券	2	21,256,920.45	0.98%	19,371.46	0.97%	-
银河证券	1	15,830,156.14	0.73%	14,426.06	0.72%	-
中信证券	2	11,317,596.00	0.52%	10,313.73	0.52%	-
招商证券	2	8,227,130.12	0.38%	7,497.43	0.38%	-
华泰证券	1	5,830,030.00	0.27%	5,312.85	0.27%	-
平安证券	1	4,840,041.87	0.22%	4,410.69	0.22%	-
国元证券	1	868,907.12	0.04%	809.19	0.04%	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-

瑞银证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	2	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准：1、经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；2、公司财务状况良好；3、有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；4、有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；5、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)产品资料概要更新	《上海证券报》及规定网站	2021-03-22
2	申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)更新招募说明书(2021年第1号)	《上海证券报》及规定网站	2021-03-22
3	申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)基金经理变更公告	《上海证券报》及规定网站	2021-03-22

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

		超过20%的时间区间					
机构	1	20210617—20210630	0.00	67,463,229.03	0.00	67,463,229.03	30.02%
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如投资者集中赎回，可能会给基金带来流动性冲击。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地管控基金的流动性风险，保护持有人利益。							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

基金合同；
 招募说明书及其更新；
 产品资料概要及其更新；
 发售公告；
 成立公告；
 定期报告；
 其他临时公告。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址：www.swsmu.com。

申万菱信基金管理有限公司

二〇二一年八月三十一日